

صندوق سرمایه گذاری مشترک کارگزاری کار آفرین

گزارش عملکرد

برای دوره مالی نه ماهه

منتهی به ۲۹ اسفند سال ۱۳۹۶

۱- اطلاعات کلی صندوق

تاریخچه تاسیس صندوق

صندوق سرمایه گذاری مشترک کارگزاری کارآفرین در تاریخ ۱۳۸۶/۰۴/۲۳ با دریافت مجوز از سازمان بورس و اوراق بهادار (سبا) به عنوان صندوق سرمایه گذاری موضوع بند ۲۰ ماده ۱ قانون بازار اوراق بهادار مصوب آذر ماه سال ۱۳۸۴، فعالیت خود را آغاز کرد. این صندوق با شماره ۱۰۵۸۱ نزد سبا و شماره ۲۸۲۶۵ نزد اداره ثبت شرکتها به ثبت رسیده است. عملکرد این صندوق بر اساس مفاد اساسنامه و امیدنامه و در چارچوب قوانین و مقررات مربوطه است.

دوره فعالیت صندوق

مدت فعالیت صندوق به موجب ماده (۵) اساسنامه، سه سال است که بر اساس آخرین تصمیمات مجمع مورخ ۱۳۹۵/۰۷/۱۴ و تأییدیه سازمان بورس تا تاریخ ۱۳۹۸/۰۷/۲۳ تمدید گردید.

محل اقامت صندوق:

مرکز اصلی صندوق در تهران، خیابان آفریقا، بلوار صبا، پلاک ۸، طبقه اول شرکت کارگزاری بانک کارآفرین واقع شده و صندوق دارای ۱۱۲ شعبه می باشد.

ارکان صندوق سرمایه گذاری

صندوق سرمایه گذاری مشترک کارگزاری کارآفرین که از این به بعد صندوق نامیده می شود از ارکان زیر تشکیل شده است:

۱-۲- مجمع صندوق، از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز تشکیل می شود. دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز به شرطی که حداقل نصف به علاوه یک واحدهای سرمایه گذاری را دارا باشند، از حق رأی در مجمع برخوردارند.

در تاریخ ترازنامه دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتازی که دارای حق رأی بوده شامل اشخاص زیر است:

ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد واحدهای تحت تملک
۱	بانک کارآفرین	۲۸,۵۰۰	۹۵
۴	شرکت کارگزاری بانک کارآفرین	۱,۵۰۰	۵
	جمع	۳۰,۰۰۰	۱۰۰

۲-۲- مدیر صندوق و مدیر ثبت : شرکت کارگزاری بانک کارآفرین است که در تاریخ ۱۳۸۵/۰۴/۰۶ با شماره ثبت ۵۹۹۳ نزد مرجع ثبت شرکت های شهرستان اردبیل به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است از تهران ، بلوار آفریقای شمالی، بلوار صبا، پلاک ۸، واحد ۷.

۲-۳- متولی صندوق، : موسسه حسابرسی و خدمات مالی فاطر است که در تاریخ ۱۳۶۱/۰۷/۰۱ به شماره ثبت ۲۳۹۱ نزد مرجع ثبت شرکت های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارتست از تهران، خیابان وصال شیرازی ، خیابان بزرگمهر غربی، کوی اسکو، شماره ۱۴ طبقه چهارم.

۲-۴- ضامن نقد شونگی صندوق ، بانک کارآفرین است که در تاریخ ۱۳۷۸/۰۹/۱۷ با شماره ثبت ۱۵۷۹۱۵ و شناسه ملی ۱۰۱۰۲۰۲۰۶۲۲۶ نزد مرجع ثبت شرکت های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی ضامن نقدشونگی عبارت است از تهران، خیابان ولیعصر، روبروی پارک ملت، ناهید غربی، شماره ۹۷.

۲-۵- حسابرس صندوق، موسسه حسابرسی فریوران است که در تاریخ ۱۳۶۶/۰۴/۲۳ به شماره ثبت ۳۳۰۹ نزد مرجع ثبت شرکت های موسسات غیر تجاری تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارتست از تهران، شهرک غرب خیابان خوردین خیابان توحید یکم پ ۱ طبقه ۵.

۲- اهداف و استراتژی های صندوق:

۲-۱- هدف از تشکیل صندوق، جمع آوری سرمایه از سرمایه گذاران و تشکیل سبدی از دارایی ها و مدیریت این سبد است؛ با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می شود، بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه گذاران گردد. انباشته شدن سرمایه در صندوق، مزیت های متعددی نسبت به سرمایه گذاری انفرادی سرمایه گذاران دارد: اولاً هزینه بکارگیری نیروهای متخصص، گردآوری و تحلیل اطلاعات و گزینش سبد بهینه اوراق بهادار بین همه سرمایه گذاران تقسیم می شود و سرانه هزینه هر سرمایه گذار کاهش می یابد. ثانیاً، صندوق از جانب سرمایه گذاران، کلیه حقوق اجرایی مربوط به صندوق از قبیل دریافت سود سهام و کپن اوراق بهادار را انجام می دهد و در نتیجه سرانه هزینه هر سرمایه گذار برای انجام سرمایه گذاری کاهش می یابد. ثالثاً، امکان سرمایه گذاری مناسب و متنوع تر دارایی ها فراهم شده و در نتیجه ریسک سرمایه گذاری کاهش می یابد.

۲-۲- صندوق فقط می تواند در دارایی های ریالی داخل کشور سرمایه گذاری کند و سرمایه گذاری خارجی (ارزی) به هر نوع و شکل غیرمجاز میباشد. صندوق در دارایی هایی به شرح زیر سرمایه گذاری می کند:

۲-۱-۲- : سهام پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران و بازار اول فرابورس؛

۲-۲-۲- : حق تقدم خرید سهام پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران و بازار اول فرابورس؛

۲-۲-۳- : اوراق مشارکت، اوراق صکوک و اوراق بهادار رهنی و سایر اوراق بهاداری که تمامی شرایط زیر را داشته باشد:

الف- مجوز انتشار آنها از سوی دولت، بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران یا سازمان بورس و اوراق بهادار صادر شده باشد؛

ب- سود حداقلی برای آن ها تضمین و مشخص شده باشد؛

ج- به تشخیص مدیر، یکی از مؤسسات معتبر بازخرید آنها را قبل از سررسید تعهد کرده باشد یا امکان تبدیل کردن آنها به نقد در بازار ثانویه مطمئن وجود داشته باشد.

۲-۲-۴- : گواهی های سپرده منتشره توسط بانک ها یا مؤسسات مالی اعتباری دارای مجوز از بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران.

۲-۲-۵- : هر نوع سپرده گذاری نزد بانک ها و مؤسسات مالی اعتباری دارای مجوز از بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران.

۳-۲- : این صندوق از نوع صندوق های سرمایه گذاری در اوراق مشارکت و سود بانکی است و اکثر وجوه خود را به شرح جدول زیر صرف خرید اوراق و سهام و سرمایه گذاری در سپرده های بانکی می کند. همچنین در طول عمر صندوق حد نصاب های زیر بر اساس ارزش روز دارایی های صندوق رعایت می شود:

حدنصاب ترکیب دارایی های صندوق سرمایه گذاری مشترک کارگزاری کارآفرین	
ردیف	موضوع سرمایه گذاری
۱	سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت، گواهی سپرده بانکی و سپرده بانکی
۱-۱-	حداقل ۷۵٪ از کل دارایی های صندوق
۱-۱-	اوراق بهادار با درآمد ثابت دارای مجوز انتشار از طرف سازمان بورس و اوراق بهادار
۲-۱-	حداقل ۳۰٪ از کل دارایی های صندوق
۲-۱-	گواهی سپرده بانکی و سپرده بانکی
۳-۱-	حداکثر ۶۰٪ از کل دارایی های صندوق
۳-۱-	اوراق بهادار منتشره از طرف یک ناشر
۴-۱-	حداکثر ۴۰٪ از کل دارایی های صندوق
۴-۱-	اوراق بهادار تضمین شده توسط یک ضامن
۲	سهام، حق تقدم سهام و قرارداد اختیار معامله سهام پذیرفته شده در بورس تهران یا بازار اول و دوم فرابورس ایران و گواهی سپرده کالایی پذیرفته شده در بورس
۱-۲-	حداقل ۵٪ و حداکثر ۲۰٪ از کل دارایی های صندوق
۱-۲-	سهام و حق تقدم سهام منتشره از طرف یک ناشر
۲-۲-	حداکثر ۵٪ از سهام و حق تقدم سهام منتشره ناشر
۲-۲-	سهام و حق تقدم سهام منتشره از طرف یک ناشر و قرارداد اختیار معامله همان سهام
۳-۲-	حداکثر ۵٪ از کل دارایی های صندوق
۳-۲-	سهام، حق تقدم سهام و قرارداد اختیار معامله سهام طبقه بندی شده در یک صنعت
۴-۲-	حداکثر ۵٪ از کل دارایی های صندوق
۴-۲-	سهام، حق تقدم سهام و قرارداد اختیار معامله سهام پذیرفته شده در بازار اول و دوم فرابورس ایران
۵-۲-	حداکثر ۵٪ از ارزش روز سهام و حق تقدم سهام
۵-۲-	اخذ موقعیت خرید در قرارداد اختیار معامله سهام
۶-۲-	حداکثر ۱۰٪ از تعداد سهام پایه موجود در پرتفوی مجاز سرمایه گذاری صندوق در سهام
۶-۲-	اخذ موقعیت فروش در قرارداد اختیار معامله خرید سهام
۷-۲-	حداکثر ۵٪ از کل دارایی های صندوق
۷-۲-	سرمایه گذاری در گواهی سپرده کالایی پذیرفته شده نزد یکی از بورس ها
۳	واحدهای سرمایه گذاری "صندوق های سرمایه گذاری" *
	حداکثر ۵٪ از کل دارایی های صندوق و تا سقف ۳۰٪ از تعداد واحدهای صندوق سرمایه پذیر که نزد سرمایه گذاران می باشد.

۴-۲- : این صندوق برای دست یابی به بازدهی بیشتر از بازدهی متوسط بورس اوراق بهادار تهران معیار محاسبه نرخ (TEDPIX) طراحی شده است. تغییرات شاخص قیمت و بازدهی نقدی متوسط بازدهی بورس تهران است.

۳- واحدهای سرمایه گذاری:

ارزش مبنای هر واحد سرمایه گذاری برابر یک میلیون ریال است که باید روی گواهی های سرمایه گذاری قید شود. واحدهای سرمایه گذاری صندوق به دو نوع ممتاز و عادی به شرح زیر تقسیم می شود:

الف) واحدهای سرمایه گذاری ممتاز که تعداد آن ها ۳۰.۰۰۰ واحد سرمایه گذاری است، قبل از شروع دوره پذیره نویسی اولیه مطابق ماده ۸، کلاً توسط مؤسس یا مؤسسان صندوق خریداری می شود. این نوع واحدهای سرمایه گذاری غیرقابل ابطال ولی قابل انتقال به غیرمی باشد.

ب) واحدهای سرمایه گذاری عادی که در طول دوره پذیره نویسی اولیه یا پس از تشکیل صندوق صادر می شود. این نوع واحدهای سرمایه گذاری قابل ابطال ولی غیرقابل انتقال می باشد. حداکثر واحدهای سرمایه گذاری عادی نزد سرمایه گذاران در امیدنامه قید شده است.

ترکیب سرمایه گذاران صندوق در تاریخ ۱۳۹۶/۱۲/۲۹ به شرح جدول زیر می باشد:

۱۳۹۶/۰۳/۳۱			
ریال	درصد	تعداد واحدها	سرمایه گذاران
۸,۷۷۷,۱۸۴,۷۹۳,۸۶۳	۹۹.۶۰	۸,۷۴۵,۳۴۳	واحدهای سرمایه گذاری عادی
۳۰,۱۰۹,۲۳۰,۰۰۰	۰.۴۰	۳۰,۰۰۰	واحدهای سرمایه گذاری ممتاز
۸,۸۰۷,۲۹۴,۰۲۳,۸۶۳	۱۰۰	۸,۷۷۵,۳۴۳	جمع

۴- اطلاعات سرمایه گذاری صندوق در ۱۳۹۶/۱۲/۲۹

۸,۸۰۷,۲۸۹,۴۹۰,۵۱۷	کل خالص دارایی ها (ریال):	✓
۱,۰۰۵,۱۷۸	قیمت صدور هر واحد سرمایه گذاری (ریال):	✓
۱,۰۰۳,۶۴۱	قیمت ابطال هر واحد سرمایه گذاری (ریال):	✓
۱,۰۱۳,۸۷۱	قیمت آماری هر واحد سرمایه گذاری (ریال):	✓
	تعداد واحد های سرمایه گذاری نزد سرمایه گذاران:	✓

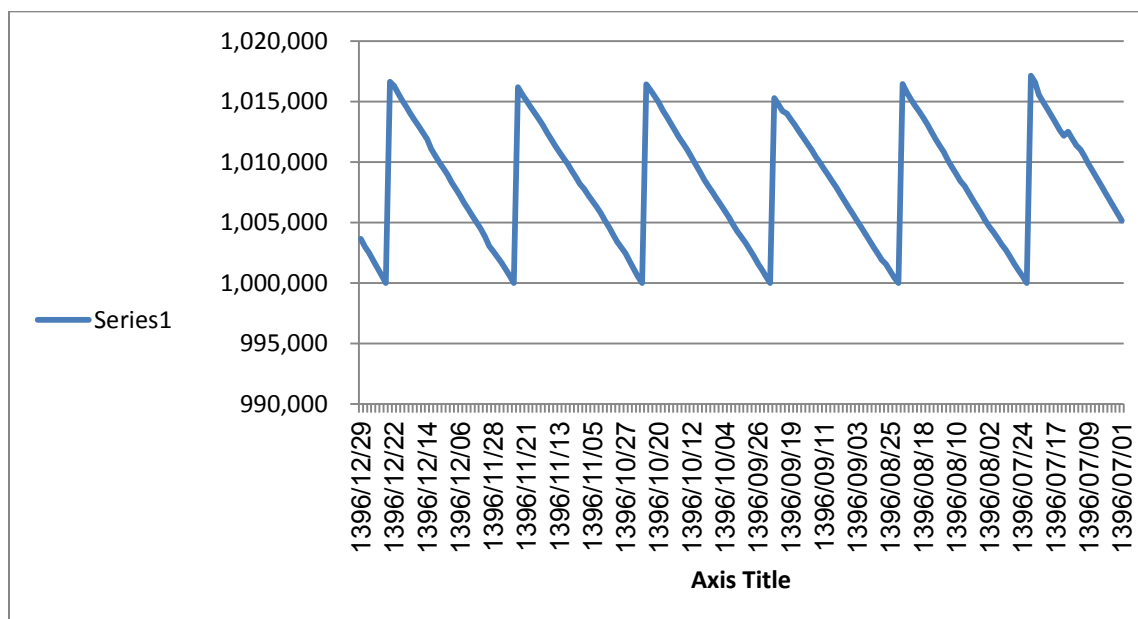
دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۲۹

ریال	تعداد	یادداشت
۱۰,۵۶۵,۲۹۲,۴۳۵,۶۹۷	۱۰,۵۱۷,۲۳۴	خالص دارایی ها (واحدهای سرمایه گذاری) اول دوره/سال
۱,۰۲۴,۷۷۵,۰۰۰,۰۰۰	۱,۰۲۴,۷۷۵	واحد های سرمایه گذاری صادر شده طی دوره/سال
(۲,۷۶۶,۶۶۶,۰۰۰,۰۰۰)	(۲,۷۶۶,۶۶۶)	واحد های سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره/سال
۹۶۳,۰۹۶,۸۵۰,۹۶۳	-	سود (زیان) خالص دوره/سال
(۹۶۷,۸۹۳,۳۸۷,۶۸۷)	-	۲۴ سود تقسیمی
(۱۱,۳۱۵,۴۰۸,۴۵۶)	-	۲۵ تعدیلات
۸,۸۰۷,۲۸۹,۴۹۰,۵۱۷	۸,۷۷۵,۳۴۳	خالص دارایی های پایان دوره/سال

۵- بازدهی صندوق طی دوره نه ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۲۹

بازده	بازده صندوق	شاخص صندوقها	شاخص بازار
هفته اخیر	۰,۳۹٪	-	۰,۰۲٪-
ماه اخیر	۱,۷۱٪	-	۲,۰۵٪-
سه ماه اخیر	۴,۹۴٪	-	۰,۸۲٪

۶- نمودار قیمت ابطال:



۸- ترازنامه در تاریخ ۱۳۹۶/۱۲/۲۹:

۱۳۹۶/۰۶/۳۱	۱۳۹۶/۱۲/۲۹	یادداشت	دارایی‌ها:
ریال	ریال		
۲۰۳,۰۳۵,۳۴۸,۰۱۱	۴۸۹,۶۴۶,۷۴۲,۰۶۶	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۵,۵۴۴,۳۹۸,۱۶۶,۹۰۰	۳,۴۶۸,۱۳۴,۴۷۴,۰۸۷	۶	سرمایه گذاری در سپرده های بانکی
۴,۹۴۳,۲۲۰,۳۲۲,۳۸۹	۴,۲۶۶,۳۴۸,۷۷۵,۱۰۹	۷	سرمایه گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
-	۴۸,۸۲۱,۸۷۳,۰۶۴	۸	سرمایه گذاری در صندوق سرمایه گذاری
۱۵,۷۶۸,۱۷۴,۶۶۲	۸,۸۷۰,۴۴۶,۱۶۷	۹	حسابهای دریافتی
-	-	۱۰	جاری کارگزاران
-	۵۵۰,۰۰۴,۳۹۳,۱۴۶	۱۱	سایر دارایی ها
۲,۹۸۲,۷۶۹	۶۷۳,۸۲۸	۱۲	موجودی نقد
۱۰,۷۰۶,۴۲۴,۹۹۴,۷۳۱	۸,۸۳۱,۸۲۷,۳۷۷,۶۶۸		جمع دارایی‌ها
			بدهی ها
۲۹,۹۲۰,۸۳۸,۹۱۴	۱۵,۱۳۴,۱۰۱,۴۱۴	۱۳	پرداختی به ارکان صندوق
۸,۲۰۳,۶۴۰,۷۶۶	۴,۴۰۷,۳۴۳,۷۴۲	۱۴	پرداختی به سرمایه گذاران
۱۰۳,۰۰۸,۰۷۹,۳۵۴	۴,۹۹۶,۴۴۱,۷۹۵	۱۵	سایر حساب‌های پرداختی و ذخایر
۱۴۱,۱۲۲,۵۵۹,۰۳۴	۲۴,۵۳۷,۸۸۶,۹۵۱		جمع بدهی‌ها
۱۰,۵۶۵,۲۹۲,۴۳۵,۶۹۷	۸,۸۰۷,۲۸۹,۴۹۰,۵۱۷	۱۶	خالص دارایی‌ها
۱,۰۰۴,۵۶۹	۱,۰۰۳,۶۴۰		خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری

۹- صورت سود زیان منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۲۹:

یادداشت	دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۲۹	دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۳۹۵/۱۲/۳۰	سال مالی منتهی به ۱۳۹۶/۰۶/۳۱
درآمد ها:	ریال	ریال	ریال
۱۷ سود (زیان) فروش اوراق بهادار	۷,۹۱۰,۲۶۸,۲۲۱	۲۳,۰۱۸,۸۶۰,۷۰۹	۷۲,۹۲۳,۷۳۱,۶۲۲
۱۸ سود (زیان) تحلیف نیافته نگهداری اوراق بهادار	(۱۷۶,۳۲۲,۷۶۵,۵۰۵)	۱۶,۰۲۳,۲۲۹,۲۲۹	۹,۹۶۹,۹۵۲,۶۶۲
۱۹ سود سهام	۷,۷۰۰,۰۰۰,۰۲۶	-	۸,۵۶۲,۹۲۸,۲۷۸
۲۰ سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	۱,۱۵۳,۵۲۹,۰۲۳,۳۷۲	۱,۵۷۸,۳۲۸,۳۳۲,۳۷۷	۳,۱۲۱,۷۷۷,۸۲۲,۸۶۲
۲۱ سایر درآمدها	۱۲۶۶,۰۷۰,۳۷۶	۶۱۳,۳۲۸,۷۲۸	۱,۱۹۸,۳۱۲,۰۲۲
جمع درآمدها	۹۹۲,۸۶۲,۱۵۳,۳۹۰	۱,۶۱۹,۱۸۳,۷۵۱,۳۳۲	۳,۳۳۲,۳۰۶,۶۴۷,۶۵۹
هزینه ها:			
۲۲ هزینه کلر مزد لگان	۲۸,۹۳۳,۲۰۹,۳۹۵	۲۰,۳۹۲,۶۲۹,۹۹۶	۸۲,۷۵۰,۶۶۹,۳۲۹
۲۳ سایر هزینه ها	۸۲۳,۰۹۳,۱۳۲	۸۶۳,۵۰۷,۶۷۰	۲,۰۹۶,۳۰۲,۸۶۰
جمع هزینه ها	۲۹,۷۶۶,۳۰۲,۵۲۷	۲۱,۲۵۸,۱۳۷,۶۶۶	۸۴,۸۴۷,۰۷۲,۱۰۹
سود (زیان) خالص	۹۶۳,۰۹۶,۸۵۰,۸۶۳	۱,۵۷۷,۸۲۵,۶۱۳,۵۷۶	۲,۱۳۹,۵۵۷,۵۷۵,۵۵۰
بازده میانگین سرمایه گذاری ^۱	۹,۶۱٪	۱۰,۶۵٪	۲۱,۳۳٪
بازده سرمایه گذاری پایان سال ^۲	۱۰,۸۱٪	۱۰,۱۸٪	۲۹,۶۳٪